泰达宏利全球新格局证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金募集申请已于2010年12月15日获中国证监会证监许可『2010』1810号文核准,基金合同于2011年7月20日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

本基金以资产组合方式投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险, 基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,境外市场特有的汇率风险及其他特定风险,等等。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其它有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人在认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日为2014年7月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日,财务数据未经审计。

一、基金的名称

泰达宏利全球新格局证券投资基金。

二、基金的类型

契约型开放式、基金中基金

三、基金的投资目标

通过全球大类资产配置和国家配置,有效地分散投资风险,精选优势区域。主动选股与基金投资相结合, 在降低组合波动性的前提下实现基金资产长期稳定增值。

四、基金的投资方向

本基金的投资范围为:公募基金(包括ETF)、股票、债券、货币市场工具,及相关法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

股票、ETF及其它类型的公募基金投资比例为基金资产的60–95%,其中投资于基金的部分不低于本基金基金资产的60%;权益类产品的配置比例不低于基金资产的60%;现金、债券及债券型基金和中国证监会允许投资的其它金融工具投资比例为基金资产的5%–40%; 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的基金资产主要投资于与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区, 投资其他国家或地区的证券资产不超过基金资产净值的10%。

五、基金的投资策略

本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略。利用定量与定性分析方法进行大类资产配置,确定权益类产品、商品类基金、现金及货币市场工具等大类资产配置比例。然后通过量化模型及主要经济体宏观经济分析,在全球进行有效的国家/地区配置。自下而上精选股票、基金,挖掘具有良好成长性且价值被低估的上市公司和具有潜力的低成本基金。各主要区域和资产配置比例为:

- ●新兴市场的目标配置比例为基金资产的0–60%;
- ●发达市场的目标比例为基金资产的0–60%;
- ●大宗商品类基金目标投资比例为基金资产的0–40%。

本基金对香港、台湾证券市场上市公司和海外上市的中国企业(注册地在中国或50%以上收入来自中国的企业)以股票投资为主,对其它国家、地区以ETF及其它类型的公募基金投资为主。

其中本基金对于新兴市场和发达市场的定义将参考所选业绩比较基准指数公司摩根士丹利资本国际的划分标准,以便在投资中更加贴近业绩比较基准。根据各国经济发展情况, 摩根士丹利资本国际目前将连续三年人均国民收入超过世界银行高收入标准线25%的国家计入发达国家指数。截止2010年5月27日,本基金所选业绩比较基准中包含24个发达市场国家,21个新兴市场国家。如果指数公司对上述划分标准进行调整,或者有更加权威、更为市场普遍接受的市场定义,基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则进行相应调整并在更新的招募说明书中进行揭示。

大宗商品类基金指以综合商品指数、单个或大类商品价格为跟踪标的、业绩比较基准90%以上是商品指数的海外市场公开发行或交易的基金和交易所上市交易的产品。所涉及的商品类别包括但是不限于黄金,石油,能源,有色金属、农产品等等。

另外,为规避汇率及市场系统性风险,本基金将遵循相关法律法规,本着审慎的原则适当地将金融衍生品引入基金资产中。

1.大类资产配置

本基金通过深入研究全球宏观经济和区域经济环境, 把握全球资本市场的变化趋势,结合量化模型及宏观策略分析确定权益类产品、商品类基金、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。

在大类资产配置过程中, 本基金运用基金管理人现有的全球资产优化配置模型(GMVS–AA)进行量化分析,提供配置建议,GMVS–AA 模型通过对宏观经济领先指标、各类资产均值回归指标(反映风险)、各类资产动量趋势指标(反映资产回报率的相对强弱)的数量化分析及优化,对各类资产进行评分,在基金约定的大类资产投资比例范围内,依据评分结果得出大类资产配置比例。公司国际投资团队结合对全球宏观经济数据、价值水平和市场气氛分析的综合判断对模型产生的结果进行评估调整,确定最终大类资产配置比例。

2.国家/地区配置

在全球经济新格局的理念下, 根据各国家和地区GDP全球占比及GDP增长贡献度,把全球分成美国、中国、欧洲、日本、澳大利亚、印度、韩国、巴西、台湾、俄罗斯、加拿大以及其它地区共十二个投资区域。其中,中国是近几年对全球GDP增长贡献度最大的国家,美国是长期全球GDP占比最高的国家,本基金会重点关注中国概念投资区域和美国市场。

本基金使用全球国家多因子优化配置模型(GMVS–CA),综合各国家地区宏观领先指标、风险水平及市场动量分析打分的结果,确定国家地区配置比例。公司国际投资团队根据对全球宏观经济及中国、美国经济形势分析结论,对模型产生的结果进行一定的调整,确定最终国家地区配置比例。

3.基金及股票的选择

(1)交易型开放式指数基金(ETF)的选择

考虑到ETF具有操作透明、成本低、流动性强等优势,ETF是本基金重点投资品种。ETF的选择标准包括:

a)ETF标的指数的市场代表性

b)ETF的跟踪误差

c)ETF的结构

d)日均交易量

e)资产管理规模

f)投资及交易成本

(2)其它类型公募基金的选择

除ETF外, 本基金拟投资的其它类型的公募基金将采取定量和定性相结合的分析方式进行筛选。

a) 定性选择

考察备选基金的基金管理人旗下基金的长期投资历史业绩和研究团队的稳定性;备选基金的基金管理人的财务状况及风险控制制度;备选基金是否符合本基金追求收益稳定持续增值且风险可控的基本投资理念。

b) 定量选择

I.所选基金的规模应居于同类基金的平均水平或以上,以满足本基金对流动性的需要。

II.超额收益率(α)和夏普比率至少要高于同类型基金的平均水平,市场风险(β)水平要至少低于同类型基金的平均水平。

III.基金业绩应与业绩比较基准保持较高的相关性,以便于基金管理人根据市场变化情况做出正确的投资判断。

IV.基金的投资成本(申购费、赎回费、管理费等)应尽量低于同类别基金。

V.第三方评级机构评级(晨星、理柏等基金评级机构)应尽可能处于同类别基金评级的前列。

(3)商品类基金投资策略

本基金从控制投资组合整体风险、抵抗通胀的角度出发,将适度配置大宗商品类基金。注重对商品基本面的深入研究,权衡其供给和需求的关系、成长性与投资价值,选取中长期持续保存较低、未来阶段性供给不足或需求超预期的商品作为主要分析对象。结合对全球宏观经济情况、各类大宗商品运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气品种,比照对ETF和其他类型公募基金的选择标准,精选具有长期增长潜力且降低组合风险的商品类基金组合。

(4)股票投资策略

本基金主动股票投资的基金资产投向香港、台湾等市场上市公司及海外上市的中国企业。借助基金管理人的投资研究平台,通过自上而下的行业配置和自下而上的个股精选策略,深入挖掘具有良好成长性及价值被低估的上市公司。

1)行业配置

在宏观经济发展的不同阶段,国民经济各行业的发展水平是有很大区别的。因此,本基金将首先考虑经济发展的特定周期,确定在某一经济周期中表现突出的行业;同时,考虑行业历史估值水平和预计未来估值水平,并与相关国家及地区的相关行业对比,得出行业可否投资的结论。具体经济评估指标包括GDP预计增长率、行业预计增长率、行业历史和预计估值水平、行业平均ROE及行业竞争态势等。之后,本基金会在综合考虑上述指标的基础之上,设定行业配置比例。

2)个股精选

本基金将在充分调查研究投资市场、行业和公司基本面的基础上,做出选股决策。建立公司预测盈利模型,对可投资的股票进行定性及定量的基本面和估值综合分析。选择成长性良好及价值被低估的股票,建立投资股票池。

a.定量筛选

按主营业务收入、主营业务利润及增长率、毛利率、净资产收益率(ROE)、资产收益率(ROA)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)等指标对基础库的股票进行综合排序、筛选,形成备选库。

b.定性分析

研究员将根据外部研究报告和实地调研情况对备选库中的股票进行定性分析,研究的内容包括两方面:

1)公司评价:包括分析公司竞争力、财务状况、发展战略、创新能力、公司治理等方面。

2)业务分析:包括对公司的业务进行逐项分析,对于不同产品特性的行业,考察的标准有所不同,对产品同质化的行业,公司业务评价包括企业规模和市场占有率等方面,对产品差异化的行业,公司业务评价包括技术优势和创新能力等方面。

4.金融衍生品投资策略

本基金为规避汇率及市场系统风险, 遵循法律法规的规定并本着审慎的原则适当地将金融衍生品引入基金资产中。

1)规避汇率风险

本基金将在法律法规许可的范围内使用外汇远期、掉期等衍生品工具来对冲外汇风险。外汇衍生品交易仅用于避险,不进行投机交易,仓位根据外汇投资头寸而定。

2)规避市场风险

在不改变本基金现有投资策略和投资比例的基础上, 基金管理人将适度使用指数衍生产品来降低所投资市场的系统性风险。指数衍生品的头寸将根据投资组合的价值及敏感度来调整,可以在一定程度上降低市场波动带来的负面影响,但不表示风险得以完全规避。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)总收益。

七、风险收益特征

本基金为基金中的基金,属于中高风险收益的基金品种,预期风险高于全球债券型证券投资基金,低于全球股票型基金。

八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定, 于2014年8月3日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2014年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	457,882.76	1.23
	其中:普通股	457,882.76	1.23
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
	房地产信托凭证	–	–
2	基金投资	25,299,454.13	68.11
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	10,558,235.58	28.43
8	其他资产	827,047.95	2.23
9	合计	37,142,620.42	100.00

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	457,882.76	1.46
合计	457,882.76	1.46

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
Consumer Discretionary	457,882.76	1.46
合计	457,882.76	1.46

4、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	TESLA MOTORS ING	特斯拉汽车公司	TSLAUS	美国纳斯达克证券交易所	美国	310	457,882.76	1.46

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本报告期末本基金未持有金融衍生品。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	MARKET VECTORS GOLD MINERS	ETF基金	开放式	Van Eck Associates Corp	2,734,058.21	8.73
2	HEALTH CARE SELECT SECTOR	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	2,619,923.77	8.37
3	INDUSTRIAL SELECT SECT SPDR	ETF基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	2,584,460.26	8.25
4	CONSUMER DISCRETIONARY SELT	ETF基金	开放式	SSgA Funds Management Inc	2,545,954.81	8.13
5	POWERSHARES DYN MEDIA PORT	ETF基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	1,823,449.96	5.82
6	ISHARES U.S. BASIC MATERIALS	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,400,241.92	4.47
7	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Management LLC	1,398,298.86	4.47
8	ISHARE U.S. Financials ETF	ETF基金	开放式	BFA	1,314,667.55	4.20
9	ENERGY SELECT SECTOR SPDR	ETF基金	开放式	SSgA Funds Management Inc	1,262,585.32	4.03
10	ISHARES MSCI IRELAND CAPPED	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,233,857.90	3.94

10、投资组合报告附注

(1)本基金投资前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本报告期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	808,674.99
3	应收股利	16,256.87
4	应收利息	128.01
5	应收申购款	1,988.08
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	827,047.95

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有流通受限的股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2011年7月20日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
本基金合同生效之日起至2011年12月31日	–2.10%	0.10%	–14.12%	1.70%	12.02%	–1.60%
2012年1月1日至2012年12月31日	–3.98%	0.68%	19.36%	0.91%	–23.34%	–0.23%
2013年1月1日至2013年12月31日	11.70%	0.51%	16.39%	0.72%	–4.69%	–0.21%
2014年1月1日至2014年6月30日	0.57%	0.55%	5.78%	0.54%	–5.21%	0.01%
本基金合同生效之日起至2014年6月30日	5.60%	0.55%	26.21%	0.99%	–20.61%	–0.44%

十、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:泰达宏利基金管理有限公司

设立日期:2002 年 6月6日

注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人:弓劲梅

组织形式:有限责任公司

联系电话:010–66577676

联系人:张萍

注册资本:一亿八千万元人民币

股权结构:北方国际信托股份有限公司:51%;宏利资产管理(香港)有限公司:49%

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司,成立于2002年6月,是中国首批合资基金管理公司之一。目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、泰达宏利聚利分级债券型证券投资基金、泰达宏利全球新格局证券投资基金、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金在内的二十多只证券投资基金。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

弓劲梅女士,董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员,天弘基金管理有限公司高级研究员,天津泰达投资控股有限公司高级项目经理,天津市泰达国际控股(集团)有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股(集团)有限公司资产管理部部长。

刘振宇先生,董事。毕业于天津师范大学和南开大学,拥有法学学士学位和经济学博士学位,律师、经济师。2000年至2002年任天津泰达集团有限公司投资部副部长。2002年至2008年任天津泰达投资控股有限公司资产管理部经理。2008年任天津市泰达国际控股(集团)有限公司总经理助理。2010年起任天津市泰达国际控股(集团)有限公司副总经理。兼任恒安标准人寿保险有限公司董事、渤海财产保险股份有限公司董事等职。

孙泉先生,董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988年任职天津开发区信托投资公司,负责信贷和外汇管理工作;1989年任职天津开发区管理委员会政策研究室, 负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作;1997年任职天津经济技术开发区总公司企划部,负责企业发展战略研究和计划经营管理工作; 2001年任职天津泰达投资控股公司资产管理部,负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理,渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

何达德先生,董事。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险(国际)有限公司首席行政总监,宏利资产管理(香港)有限公司首席行政总监,负责宏利于香港的全线业务,包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险(国际)有限公司及宏利资产管理(香港)有限公司之董事。何先生毕业于英国伦敦城市大学,取得精算学荣誉理学士学位,现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员,在寿险及退休顾问工作方面拥有三十年的丰富经验,其间担任多个领导层职职。

雷柏剛(Robert Allen Cook)先生,加拿大国籍,董事。毕业于加拿大多伦多大学及卡尔加里大学,持有金融学工商管理硕士学位。雷先生为宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理,并为宏利金融执行委员会成员。雷先生统领宏利金融于中国内地、香港、印尼、日本、马来西亚、菲律宾、新加坡、台湾、泰国、越南等地的业务发展。雷先生于2007年出任现职前曾担任美国保险业务部行政副总裁,掌管恒康人寿保险、恒康长期护理、恒康金融网络等业务单位。 雷先生服务宏利逾三十载,历任美国、加拿大、国际及企业业务部多项管理要职,曾驻多伦多、沃特卢、波士顿、英格兰等地,现常驻香港。雷先生于策略规划、保险及年金产品管理、销售、市场推广等领域均饶富经验。现任宏利金融亚洲区高级行政副总裁兼总经理、宏利国际控股有限公司总裁兼首席行政总监及宏利资产管理(香港)有限公司主席。

杜汶高先生,董事。毕业于美国卡内基美隆大学,持有数学及管理科学理学士学位,现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事,掌握亚洲及日本的投资事务,专责管理宏利于区内不断壮大的资产,并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前,杜先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001年至2004年,负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于2001年加入宏利,之前任职于一家环球评级机构,曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管,拥有二十三年的资本市场经验。

刘青山先生,董事。毕业于中国人民大学,史学学士和管理学硕士。1997年就职于华夏证券基金部,参与筹建华夏基金管理公司,从事投资研究工作。2001年起参与筹建湘财合丰基金管理公司(泰达宏利基金管理有限公司前身)并工作至今,期间历任研究部负责人、基金经理、投资副总监,投资总监兼总经理助理、副总经理兼投资总监。2013年3月起任泰达宏利基金管理有限公司总经理。

汪丁丁先生,独立董事,毕业于北京师范学院数学系,中国科学院数学力学部理学硕士学位,1990年获夏威夷大学经济学博士学位。1984年至1998年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜依斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授,自2007年至今,担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生,独立董事。毕业于浙江大学法学院,中国政法大学法学硕士学位、民商法法学博士学位。1990年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《信托法》、《证券投资基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

杜英华女士,独立董事,任期始于2014年6月20日。毕业于南开大学法律系,获得法学学士和法学硕士学位。1992年10月,与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所,现任该律所副主任,正高级律师,具有22年法律实务经验。同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

范小云女士,独立董事,毕业于南开大学金融学系,经济学博士学位。毕业于南开大学金融学系,经济学博士学位。1997年至2005年历任南开大学金融学系讲师、副教授,2005年起任南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任。2001年至2005年担任《南开经济研究》副主编。目前为教育部哲学社会科学重大攻关项目首席专家,南开大学金融学系教授、副主任、国际金融研究中心主任;兼任中国金融学会理事、中国国际金融学会理事。

2、监事会成员

邢吉海先生,监事,本期任期始于2010年3月31日。毕业于天津干部管理学院财会专业,会计师。1995年至1997年任天津泰达国际酒店集团副总经理兼财务总监;1997年至2000年任职于天津经济开发区财政局;2000年至2001年任天津开发区总公司财务中心主任;2001年起任天津泰达投资控股有限公司财务中心主任。现任天津泰达投资控股有限公司总经理助理。

任赛华女士,监事。毕业于加拿大滑铁卢大学(University of Waterloo),获得数学学士学位, 加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于2007年加盟,曾任首席行政事务总监,现担任宏利资产管理高级执行总监。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会,监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。

王泉先生,职工监事。管理学学士、经济学硕士。2002 年3 月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今,历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理。

邓艺颖女士,职工监事。金融学硕士,2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部职员;2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部总监业务助理兼研究员;自2011年6月3日起担任泰达宏利价值优化型成长类行业证券投资基金基金经理;具备9年基金从业经验,8年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

3、总经理及其他高级管理人员

刘青山先生,总经理。简历同上。

傅国庆先生,副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学,获文学学士和工商管理硕士学位。1993年至2006年就职于北方国际信托股份有限公司,从事信托业务管理工作,期间曾任办公室主任、研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006年9月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监。

张萍女士,督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院,管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司,从事财务管理和管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作,任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

刘威女士,2005年1月至2006年1月就职于英国Futex Trading Ltd,从事欧洲债券市场分析与交易工作;2006年4月至2008年4月就职于英国Fundamental Data Ltd,从事基金分析与研究工作;2008年4月至2008年6月就职于英国Crosby Forsyth Partners, 从事研究工作;2008年7月至2009年4月就职于英国ODL Securities,从事研究工作;2009年4月加入泰达宏利基金管理有限公司,担任国际投资部基金经理助理;2013年4月9日起担任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理。具备7年基金从业经验,7年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

本基金历任基金经理:王咏辉先生,自2011年7月至2012年8月管理本基金。胡兴先生,自2012年5月至2013年4月管理本基金。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理刘青山,总经理助理兼投资总监梁辉,研究部总监兼基金经理陈少平,基金投资部副总经理吴俊峰。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

十一、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费,含境外托管人收取的费用;

3. 基金依照有关法律法规应当缴纳的,与购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用);

4.基金合同生效后的基金信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用;

7. 因基金的证券交易或结算而产生的费用、所投资基金的销售费用和管理费用及在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用;

8.外汇兑换交易的相关费用;

9. 基金的资金汇划费用;

10.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;

11.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.8%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定,履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定,履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外,基金管理人和基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收, 基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

十二、基金托管人

一、基金托管人情况

(一)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:田 青

联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”,中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市, 是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年12月31日, 中国建设银行资产总额153,632.10亿元, 较上年增长9.95%; 客户贷款和垫款总额85,900.57亿元, 增长14.35%; 客户存款总额122,230.37亿元,增长7.76%。营业收入5,086.08亿元,较上年增长10.39%,其中,利息净收入增长10.29%,净利息收益率(NIM)为2.74%;手续费及佣金净收入1,042.83亿元,增长11.52%,占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制,成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元,较上年增长11.28%;净利润2,151.22亿元,增长11.12%。资产质量保持稳定,不良贷款率0.99%,拨备覆盖率268.22%;资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%,保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个,服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户,与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系;在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年,本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可,先后荣获国内外102项奖项,多项综合排名进一步提高,在英国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5,较上年上升2位;在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中,位列第2,较上年上升13位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托投权市场处、OFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室, 在上海设有投资托管服务上海备份中心, 共有员工220余人。自2007年起, 托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事